

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Modelo MRC MI01

- (1) Modelo aplicável quando as instituições estejam autorizadas pelo Banco de Portugal a calcular os requisitos de fundos próprios para cobertura dos riscos de posição da carteira de negociação e dos riscos cambiais e de mercadorias em relação ao conjunto da sua actividade de acordo com modelos internos.
- (2) O valor a inscrever nesta coluna corresponde, conforme o disposto no subponto 8.2, do Anexo VII do Aviso n.º 8/2007, à média dos valores diários em risco verificados nos 60 dias úteis anteriores, multiplicada por um factor de, pelo menos, 3 e corrigida pelo factor referido no ponto 13 do mesmo Anexo. Exclui o montante de risco de incumprimento adicional, o qual deve ser inscrito na coluna 3.
- (3) O valor a inscrever nesta coluna corresponde, conforme o disposto no subponto 8.1, do Anexo VII do Aviso n.º 8/2007, ao valor-em-risco do dia anterior, excluindo o montante de risco de incumprimento adicional, o qual deve ser inscrito na coluna 3.
- (4) Montante de risco de incumprimento adicional, calculado nos termos da alínea c) do subponto 17.2 ou do ponto 18, do Anexo VII do Aviso n.º 8/2007.
- (5) Conforme o disposto no ponto 13, do Anexo VII do Aviso n.º 8/2007.
- (6) Conforme resulta do disposto no Quadro 1, do Anexo VII do Aviso n.º 8/2007.